

首创证券创赢增利 2 号集合资产管理计划

修改合同的征求及回复意见函二

广发银行股份有限公司：

根据最新的投资运作需要，需对我司发行管理并由贵行托管的首创证券创赢增利 2 号集合资产管理计划的《首创证券创赢增利 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”）进行更改，相应更改内容在托管协议、计划说明书、风险揭示书中对应的条款同步更改。

具体更改内容如下：

一、资产管理合同第五章“集合资产管理计划的基本情况”的“（五）投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级”中，原：

“4. 产品风险等级

本集合资产管理计划的风险等级为【R3】（中等风险），适合风险承受能力等级匹配且法律法规及监管规定允许投资的个人投资者、机构投资者，及监管机构允许投资本集合计划的其他投资者。”

变更为：

“4. 产品风险等级

本集合资产管理计划的风险等级为【R2】（中低风险），适合风险承受能力等级匹配且法律法规及监管规定允许投资的个人投资者、机构投资者，及监管机构允许投资本集合计划的其他投资者。”

二、资产管理合同第五章“集合资产管理计划的基本情况”的“（十）封闭期、开放期安排”中，原：

“2、开放期：

首个开放日为本资产管理计划成立之日起满 2 个月后的对应日（若为非交易日顺延至下一个交易日），首次开放结束后，每月开放一次，可办理参与或退出

业务。投资于本计划的每笔资金参与后封闭 2 年，封闭期间不允许赎回该笔资金。如委托人持有份额满足 2 年封闭期要求，可以在对应参与日 2 年后的任一开放日内提起份额赎回申请。具体的开放安排以管理人公告为准。本集合计划合同变更时，管理人有权设置临时开放期，不同意合同变更的委托人可在临时开放期退出集合计划。临时开放期仅允许赎回，不允许申购。”

变更为：

“2、开放期

本集合资产管理计划每月开放一次，具体的开放日为每月 15 日，若开放日遇法定节假日、休息日等则自动顺延至下一个交易日。开放日可为投资者办理参与业务，投资者持有份额每满 15 个月方可在开放日办理对应份额赎回业务。若投资者持有份额在满 15 个月的对应开放赎回日未进行份额赎回，则该笔份额可以在之后每个月的开放日进行赎回。具体的开放安排以管理人公告为准。

本集合计划合同变更时，管理人有权设置临时开放期，不同意合同变更的委托人可在临时开放期或变更生效前的开放日退出集合计划。因合同变更设置的临时开放期内，申请退出的份额不受上述持有时长的限制。临时开放期仅允许赎回，不允许申购。”

资产管理合同第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”的“(二)参与和退出的开放日及时间”中做相应变更。

三、资产管理合同第五章“集合资产管理计划的基本情况”的“(十二)本集合计划的各项费用”中，原：

“1、认购费/参与费:0%

2、托管费: 0.03%/年

3、管理费: 1.0%/年

4、退出费: 0%

5、业绩报酬: 参见合同集合计划的费用、业绩报酬部分

6、其他费用：参见合同集合计划的费用、业绩报酬部分”

变更为：

“1、认购费/参与费:0%

2、托管费：0.03%/年

3、管理费：0.70%/年

4、退出费：0%

5、业绩报酬：以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如发生上一个业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，则为份额确认日，下同）至本次业绩报酬计提日的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准，按照业绩报酬计提基准以上部分的 60%提取业绩报酬。

6、其他费用：其他费用由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。”

四、资产管理合同第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”的“(七)参与份额与退出金额的计算方式”中，原：

“1、参与份额计算

参与份额=参与金额÷参与日计划单位净值

集合计划份额面值为 1.00 元。委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。”

变更为：

“1、参与份额计算

参与份额=参与金额÷参与日计划单位净值

委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。”

五、资产管理合同第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”的“(十六) 管理人自有资金参与集合计划”中，原：

“管理人可选择以自有资金参与本集合计划份额。

(1) 自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

(2) 自有资金参与的金额和比例：自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的 20%。

(3) 自有资金退出的条件：管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于 6 个月。

(4) 因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限时的处理原则及处理措施：因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，管理人在满足持有期限要求且约定责任解除后，管理人将在 5 个工作日内公告退出安排。

(5) 信息披露：管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应该提前 5 个工作日通过管理人网站公告。

(6) 自有资金责任承担方式和金额：管理人自有资金参与的享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。

(7) 收益分配以管理人的公告为准。”

变更为：

“管理人可选择以自有资金参与本集合计划份额。

(1) 自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《指导意见》《管理办法》《管理规定》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

(2) 自有资金参与的金额和比例：自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的 50%。

(3) 自有资金退出的条件：管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不

得低于 6 个月。

(4) 因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限时的处理原则及处理措施：因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，管理人在满足持有期限要求且约定责任解除后，管理人将在 5 个工作日内公告退出安排。

(5) 信息披露：管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应该提前 5 个工作日通过管理人网站公告。

(6) 自有资金责任承担方式和金额：管理人自有资金参与的享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。

(7) 收益分配以管理人的公告为准。”

六、资产管理合同第十一章“资产管理计划的投资”的“(四) 风险收益特征”中，原：

“本计划属于中等风险 R3 的证券投资产品。”

变更为：

“本计划属于中低风险【R2】的证券投资产品。”

七、资产管理合同第十四章“利益冲突及关联交易”中，原：

“2、临时报告

集合计划存续期间，管理人运用受托管理资产从事关联交易的，应当按照规定编制信息披露公告，披露下列信息：

- (1) 交易概述及交易标的的基本情况；
- (2) 交易各方的关联关系和关联方基本情况；
- (3) 交易的定价政策及定价依据；
- (4) 交易协议的主要内容，包括交易价格、交易结算方式、协议生效条件、

生效时间、履行期限等；

(5) 交易决策及审议情况；

(6) 管理人认为应当披露的其他信息。

本集合计划运用受托管理资产从事关联交易的，应当于签订交易协议后 10 个工作日内（无交易协议的，自事项发生之日起 10 个工作日内），按照规定在管理人网站发布信息披露公告。”

变更为：

“2、临时报告

集合计划存续期间，管理人运用受托管理资产从事关联交易的，应当按照规定编制信息披露公告。

本集合计划运用受托管理资产从事关联交易的，应当于签订交易协议后 10 个工作日内（无交易协议的，自事项发生之日起 10 个工作日内），按照规定在管理人网站发布信息披露公告。

3、本集合计划未聘请投资顾问，不存在与投资顾问之间存在利益冲突情形。”

八、资产管理合同第十八章“越权交易的界定”新增：

“（四）越权交易的例外

以下不属于越权交易情形：

1、非因管理人主观原因导致本集合计划投资比例不符合本合同约定；

2、本集合计划终止前 10 个交易日内，管理人对所投资的资产进行变现造成投资比例不符合本合同约定。”

九、资产管理合同第二十章“资产管理计划的费用与税收”的“（二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间”中，原：

“2、管理人管理费计提和支付：

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为 1.0%。计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一自然日集合计划资产净值

管理人的管理费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次，经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。”

变更为：

“2、管理人管理费计提和支付：

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为 0.70%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.70\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一自然日集合计划资产净值

管理人的管理费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次，经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。”

原：

“5、审计费用

本集合计划的年度审计费用，按管理人与会计师事务所确定的金额，在被审计的会计年度期间，自确认费用开始按直线法在当年年度剩余的每个自然日内平均计提。”

变更为：

“5、审计费用

本集合计划的年度审计费用，按管理人与会计师事务所确定的金额，审计费用按年度一次性计提。”

十、资产管理合同第二十二章“信息披露与报告”的“（一）定期报告”中，原：

“2、集合计划的资产管理季度报告

管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的季度报告，报告包括但不限于以下内容：

（一）管理人履职报告；

（二）托管人履职报告；

（三）资产管理计划投资表现；

（四）资产管理计划投资组合报告；

（五）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；

（六）资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；

（七）资产管理计划投资收益分配情况；

（八）投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；

（九）若本计划投资国债期货的，季度报告还应披露集合计划参与国债期货交易的有关情况，包括投资目的，持仓情况，损益情况，投资国债期对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的等。

（十）中国证监会及自律组织规定的其他事项。

资产管理季度报告由管理人、托管人编制，由管理人公告，每季度结束之日起一个月内通过管理人网站披露季度报告，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。本集合计划成立

不足三个月或者存续期间不足三个月的，可以不编制当期的季度报告。

3、集合计划的资产管理年度报告

管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，年度报告包括但不限于以下内容：

- （一）管理人履职报告；
- （二）托管人履职报告（如适用）；
- （三）资产管理计划投资表现；
- （四）资产管理计划投资组合报告；
- （五）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- （六）资产管理计划财务会计报告；
- （七）资产管理计划投资收益分配情况；
- （八）资产管理计划投资收益分配情况；
- （九）投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；

（十）中国证监会规定的其他事项。资产管理年度报告由管理人、托管人编制，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送证券公司住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构。托管人在每年度向委托人提供一次托管报告。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的年度报告。

4、年度审计报告

管理人进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本集合资产管理计划出具单项审计意见。管理人在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人提供。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人可不提供审计报告。

管理人应当将审计结果按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。”

变更为：

“2、集合计划的资产管理季度报告

管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的季度报告，报告包括但不限于以下内容：

- （一）管理人履职报告；
- （二）托管人履职报告；
- （三）资产管理计划投资表现；
- （四）资产管理计划投资组合报告；
- （五）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；

（六）资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；

- （七）资产管理计划投资收益分配情况；
- （八）投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- （九）中国证监会及自律组织规定的其他事项。

资产管理季度报告由管理人、托管人编制，由管理人公告，每季度结束之日起一个月内通过管理人网站披露季度报告，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，可以不编制当期的季度报告。

3、集合计划的资产管理年度报告

管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，年度报告包括但不限于以下内容：

- （一）管理人履职报告；
- （二）托管人履职报告（如适用）；
- （三）资产管理计划投资表现；

- (四) 资产管理计划投资组合报告;
- (五) 资产管理计划运用杠杆情况 (如有);
- (六) 资产管理计划财务会计报告;
- (七) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬 (如有) 等费用的计提基准、计提方式和支付方式;
- (八) 资产管理计划投资收益分配情况;
- (九) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项;
- (十) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理年度报告由管理人、托管人编制, 并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。托管人在每年度向委托人提供一次托管报告。本集合计划成立不足 3 个月时, 管理人/托管人可不编制披露当期的年度报告。

4、年度审计报告

管理人进行年度审计, 应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计, 并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本集合资产管理计划出具单项审计意见。管理人在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告通过管理人网站向委托人提供。本集合计划成立不足 3 个月时, 管理人可不提供审计报告。

管理人应当将审计结果按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。”

十一、资产管理合同第二十四章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”的“(一) 合同的变更”中, 原:

“1、本合同签署后, 因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所、基金业协会、证券业协会等交易规则修订, 自该修订生效之日起, 本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商, 可以对本集合计划合同及说明书与新的

法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改,更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定,更新或修改的内容在管理人网站公告满 10 个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议,管理人将在生效日之前三个工作日设置临时开放期,委托人可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。”

变更为:

“1、本合同签署后,因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所、基金业协会、证券业协会等交易规则修订,自该修订生效之日起,本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商,可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改,更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定,更新或修改的内容在管理人网站公告之日起生效。委托人对更新或修改的内容有异议,可在更新或修改内容生效前按照管理人开放公告中约定的开放日申请退出本集合计划。”

若产品合同变更条款涉及到风险揭示书和计划说明书,对应一并修改。



回 执

首创证券股份有限公司：

贵司《首创证券创赢增利 2 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函二》已收悉。我行对该集合资产管理计划合同修改的意见如下：

我行同意按照贵司来函中所列明的内容，对首创证券创赢增利 2 号集合资产管理计划资产管理合同、托管协议、风险揭示书、计划说明书进行修改，请贵司按照相关法律法规和资产管理合同的相关规定进行产品变更备案，并及时、充分履行信息披露义务。

广发银行股份有限公司
2017年 7 月 4 日

